

证券代码：601512

证券简称：中新集团

公告编号：2022-010

## 中新苏州工业园区开发集团股份有限公司

### 关于控股子公司开展期货套期保值业务的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

中新苏州工业园区开发集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年3月31日召开第五届董事会第三十五次会议，审议通过了《关于苏州东吴热电有限公司开展动力煤期货套期保值业务的议案》，公司控股子公司苏州东吴热电有限公司（以下简称“东吴热电”或“子公司”）拟开展套期保值保证金额度不超过人民币5,000万元的套期保值业务，使用期限为自公司董事会审议通过之日起12个月内，上述额度可循环滚动使用。现将有关情况公告如下：

#### 一、开展期货套期保值业务控股子公司的基本情况

1、企业名称：苏州东吴热电有限公司

2、注册地址：苏州工业园区娄葑镇东南区朝前工业区。

3、注册资本：人民币15,278万元

4、股权结构：公司控股子公司中新苏州工业园区市政公用发展集团有限公司（以下简称“中新公用”）持股占比51.88%，上海华电电力发展有限公司持股占比24.8%，苏州工业园区国有资本投资运营控股有限公司持股占比14.32%，苏州恒能投资有限公司持股占比9%。

5、财务状况：截至2021年9月30日，资产总额38,385万元，净资产合计28,353万元。2021年前三季度实现利润总额为682万元，净利润531万元（未经审计）。

#### 二、拟开展的套期保值业务的情况

1、期货品种：郑州商品交易所交易的动力煤期货。

2、套期保值业务规模：东吴热电拟设定年度动力煤套期保值数量不超过10

万吨，约占东吴热电年消耗煤量的50%；年度套期保值合约金额不超过1亿元。套期保值保证金额度不超过人民币5,000万元，上述额度可循环滚动使用。授权中新公用管理层办理与之相关的一切手续。

3、资金来源：套期保值业务资金为东吴热电自有资金。

4、使用期限：自公司董事会审议通过之日起12个月内。

5、开展套期保值的必要性和意义：东吴热电承担苏州工业园区南部区域集中供热任务，2021年以来，煤炭价格波动较大，严重影响东吴热电煤炭采购成本，对保障区域能源供应形成挑战。通过借助动力煤期货市场的价格发现、风险对冲功能，利用套期保值工具规避动力煤现货市场价格波动风险，锁定生产经营成本，维护子公司生产经营的稳定，保障区域能源稳定供应。

### 三、套期保值面临的风险

1、市场交易风险：市场走势判断相反、保证金不足被强制平仓、流动性不足无法平仓；

2、实物交割风险：交割商品质量标准、运输交货时间不达预期的风险及增值税问题等；

3、基差风险：期货、现货价格走势未按预期上涨或背离，影响套保效果；

4、决策风险：期货市场的进入时机和平仓的价格点位判断失误影响套保交易效果；

5、内控执行风险：内控制度设计严格，执行不到位导致的重大风险；

6、操作风险：期货交易专业性较强，可能会由于内控制度不完善造成风险；

7、技术风险：主要是信息系统，风险测量系统的不完善造成的风险。

### 四、套期保值的风险控制措施

子公司建立套期保值业务内部控制制度，规定套期保值业务的组织体系、职责分工、业务流程、风险控制、考核评价等具体要求，严格按照董事会批准的权限内办理期货套期保值业务，并严格按照内控制度执行，风险控制策略如下：

1、借助专业咨询机构力量，加强市场走势判断能力；密切跟踪交易情况，

确保保证金处于安全额度，预留一定数额的风险准备金；尽量选择交易量比较大的主力合约进行套期保值；在已经确认对实物合同进行套期保值的情况下，期货头寸的建立、平仓要与所保值的实物合同在数量、时间上相匹配。落实监督和跟踪每笔交易的执行情况，发现、报告并按照程序处理风险事件；

2、严格执行郑州商品交易所《期货交割细则》，如现货市场货源充足、基差有利，可尽量避免实物交割；

3、期货、现货价格走势背离时尽量避免操作；

4、以经营目标为中心、以保值为目的确定开仓价位，严格按照套期保值方案控制仓位；依托合作的期货公司专业市场行情分析及专业业务能力，为子公司套期保值业务提供参考依据；

5、不断完善内控制度及监督机制，并确保有效运行；

6、加强业务人员能力的培训和学习，不断完善操作流程；

7、建立符合交易要求的通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行。

## **五、套期保值的会计政策及核算原则**

公司动力煤套期保值业务会计处理将严格按照《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》及《企业会计准则第24号—套期保值》相关规定进行核算。

## **六、独立董事意见**

控股子公司使用自有资金开展期货套期保值业务的相关审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。控股子公司已建立《期货套期保值业务内部控制制度》，组织机构健全完善，并配备相关专业人员，业务流程符合相关规定；套期保值期货品种仅限于与控股子公司生产经营有直接关系的动力煤，不存在损害公司和全体股东利益的情况。综上所述，我们认为子公司开展期货套期保值作为子公司防范和化解价格波动风险的有效工具，通过加强内部控制和管理，落实风险防范措施，有利于子公司实现持续稳定的经营效益。子公司参与期货套期保值交易是必要的，风险是可以控制的。

特此公告。

中新苏州工业园区开发集团股份有限公司董事会

2022年4月1日